

## 上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金资产的估值和运用基金资产、但不保证基金业绩。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 上证180高贝塔ETF

基金王代码 510450

交易代码 510450

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2013年7月8日

报告期末基金份额总额 52,920,713.00份

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数

量化风险管理手段，力求控制本基金的净值增长率与业绩比较

基准之间的日均跟踪偏离度不超过±0.3%，年跟踪误差不超过

2%，以实现对上证180高贝塔指数组的有效跟踪。

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股及其权重的变

对股票组合进行动态调整，但因特殊情况下导致基金无法有效跟踪

的指数时，本基金将采用其他方法建立实际组合，力求实现

基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

上证180高贝塔指数收益率

本基金为股票型基金，长期平均风险和预期收益率高于混合型

基金，债券型基金，货币市场基金等，为高风险、高收益产品。本

基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现

，具有典型的指数特征，以及标的指数所代表的股票市场相似的

风险收益特征。

基金管理人 上投摩根基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

1.本期已实现收益 -317,455.57

2.本期利润 -2,702,915.33

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0657

4.期末基金份额净值 55,382,596.54

5.期末基金份额净值 1.0465

注:本期已实现收益指收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收入加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.89% 1.29% -4.15% 1.31% -0.74% -0.02%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金

累计的基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年7月8日至2013年12月31日)

注:本基金合同生效日为2013年7月8日，截至报告期末本基金合同尚未满一年。根据基金合同的

规定，本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月内，本基金在本报告期末尚处在建仓期内。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任职日期 离任日期

黄栋 本基金基金经理 2013-7-8 - 9年

上海财经大学经济学硕士；2005年至2010年先后在东证、工银瑞信基

金从事金融工程研究工作；2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公

司，主要从事金融工程研究方面的工

作。2012年7月起担任上投摩根中证

消费服务领先指数证券投资基金基

金经理，自2013年7月1日起同时担任上

证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:1.任本基金期间和离任日期均为公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.黄栋先生为本基金基金经理，其任职日期为本基金基金合同生效日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

在报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规，《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及基金招募说明书的规定，基金管理人对基金的投资决策、基金交易行为等投资管理活动不存在违反基金合同和法律法规的规定情形。

5.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金公平交易制度指导意见》等相关法律法

规和公司内部公平交易的各项要求，严防规则内漏而产生不公平交易行为，本公司通过对

账户操作、定期报告、交易对手分析、交易记录分析、异常交易监控、绩效评价等手段对投资组合在投

资交易行为、公平交易执行情况进行定期和不定期的专项稽查。

5.2 公平交易制度的执行情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.3 公平交易制度的执行情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.4 报告期内基金的公平交易情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.5 报告期内基金的公平交易情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.6 报告期内基金的公平交易情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.7 报告期内基金的公平交易情况

对于交易对象选择、交易时机选择、交易定价等公平交易执行情况，本公司执行公平交

易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照

时间优先、比例分配的原则，在各投资组合之间公平分配交易量。

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

8.1.2 《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

8.1.3 《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；

8.1.4 《上投摩根开放式基金业务规则》；

8.1.5 《基金管理人业务资格批件、营业执照》；

8.1.6 《基金托管人业务资格批件、营业执照》；

8.2 备查文件

8.2.1 基金合同、基金章程；

8.2.2 基金托管协议；

8.2.3 基金募集申请报告；

8.2.4 基金验资报告；

8.2.5 基金份额发售公告；

8.2.6 基金募集临时公告；

8.2.7 基金上市公告书；

8.2.8 基金定期报告、半年度报告和年度报告；

8.2.9 基金临时公告；

8.2.10 基金份额净值公告、份额累计净值公告；

8.2.11 基金份额申购、赎回价格公告；

8.2.12 基金份额上市交易公告书；

8.2.13 基金份额折算公告；

8.2.14 基金收益分配公告；

8.2.15 基金费用披露公告；

8.2.16 基金上市交易公告书；

8.2.17 基金清算报告；

8.2.18 基金信息披露报告；

8.2.19 基金客户服务指南；

8.2.20 基金代销机构情况；

8.2.21 基金销售机构信息；

8.2.22 基金销售费用；

8.2.23 基金销售服务；

8.2.24 基金销售支付；

8.2.25 基金销售宣传；

8.2.26 基金销售咨询；

8.2.27 基金销售投诉；

8.2.28 基金销售争议解决；

8.2.29 基金销售监管；

8.2.30 基金销售自律；

8.2.31 基金销售统计；

8.2.32 基金销售评价；

8.2.33 基金销售预测；

8.2.34 基金销售评估；

8.2.35 基金销售奖励；

8.2.36 基金销售激励；

8.2.37 基金销售激励；

8.2.38 基金销售激励；

8.2.39 基金销售激励；

8.2.40 基金销售激励；

8.2.41 基金销售激励；

8.2.42 基金销售激励；

8.2.43 基金销售激励；

8.2.44 基金销售激励；

8.2.45 基金销售激励；

8.2.46 基金销售激励；

8.2.47 基金销售激励；

8.2.48 基金销售激励；

8.2.49 基金销售激励；

8.2.50 基金销售激励；

8.2.51 基金销售激励；

8.2.52 基金销售激励；

8.2.53 基金销售激励；

8.2.54 基金销售激励；

8.2.55 基金销售激励；

8.2.56 基金销售激励；

8.2.57 基金销售激励；

8.2.58 基金销售激励；

8.2.59 基金销售激励；

8.2.60 基金销售激励；

8.2.61 基金销售激励；

8.2.62 基金销售激励；